

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/12/2022

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

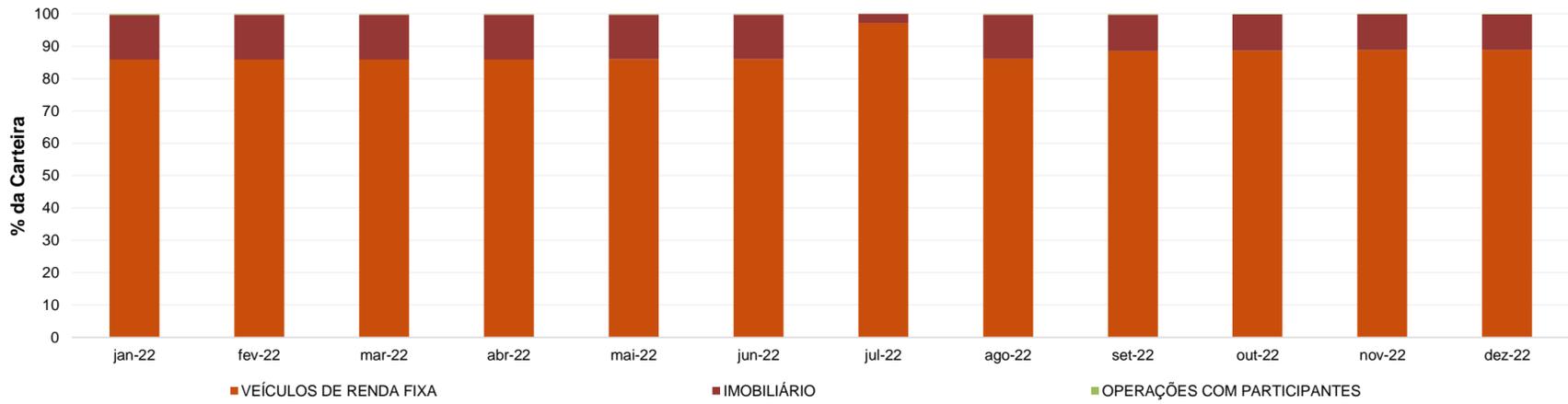
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	46.405.581,57	88,85%				0,87%	3,10%	6,19%	11,88%	11,88%	15,64%	21,22%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Renda Fixa	46.405.581,57	88,85%										
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	46.316.751,88	88,68%	BRADESCO	0,57%	0,02%	1,11%	3,14%	6,49%	12,07%	12,07%	16,86%	19,65%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	4.726,99	0,01%	BRASIL PLURAL	0,00%		1,43%	4,08%	8,48%	16,29%	16,29%	25,63%	33,61%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	84.102,70	0,16%	GENIAL	0,00%		1,43%	4,08%	8,48%	16,29%	16,29%	25,63%	33,61%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Imobiliário	5.709.246,98	10,93%				-0,20%	-0,70%	-0,24%	0,85%	0,85%	-0,33%	6,33%
Benchmark:	CDI + 1% a.a.					1,21%	3,45%	7,15%	13,49%	13,49%	19,66%	24,20%
Imóveis	4.717.125,59	9,03%				-0,06%	-0,17%	-0,34%	-0,65%	-0,65%	-1,32%	-7,77%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	992.121,39	1,90%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR	992.121,39	1,90%		100%		-0,87%	-3,11%	0,09%	7,72%	7,72%	5,37%	17,04%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Operações com Participantes	91.025,43	0,17%				96,58%	-10,95%	12,87%	-2,50%	-2,50%	-11,68%	-20,19%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Total	52.229.869,18	100%			0,07%	0,84%	2,64%	5,44%	10,43%	10,43%	13,84%	17,93%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1,05%	2,58%	2,40%	10,36%	10,36%	26,66%	39,15%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC. O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

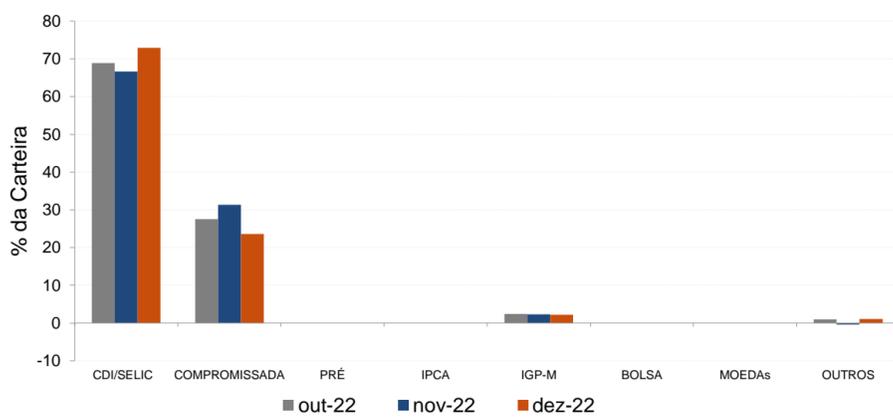
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

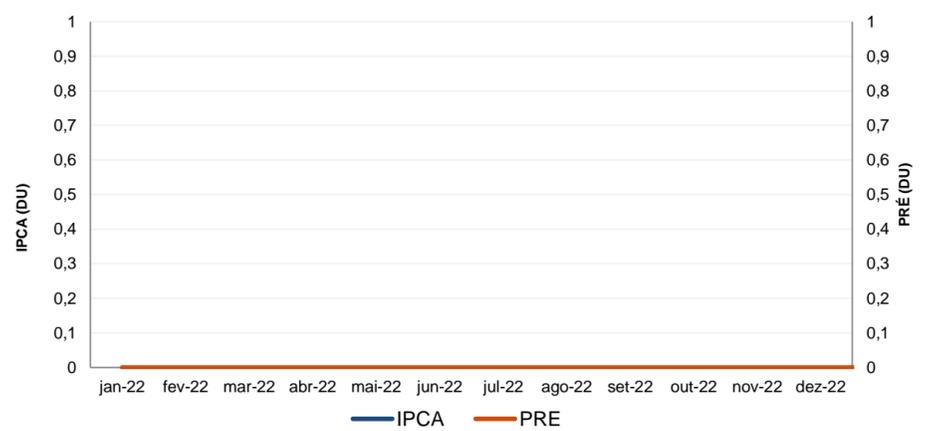
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/12/2022

Análises de Contrapartes

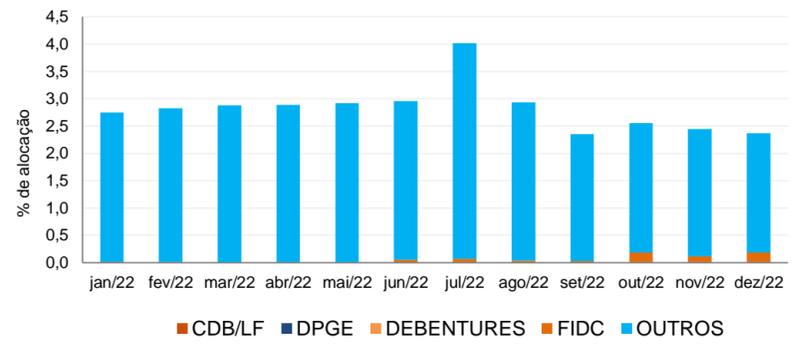
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1.035,22	2,18	Sem Faixa

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são chegadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/12/2022

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta. É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-09-01	01-set-25	214.992	0,45%	Selic	01-dez-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	711.912	1,50%	Selic	28-dez-22	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	420.028	0,88%	Selic	07-dez-22	0,16%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT

